

views如何求股票日波动率；用GARCH模型计算波动率的具体步骤是怎样的？特别是参数估计-股识吧

一、如何计算股票的波动率

财富创业板技巧：下面以计算股票的历史波动率为例加以说明。

- 1、从市场上获得标的股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。
- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价与该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有 250 个交易日，应乘以根号250)，得到的即为历史波动率。

历史波动率是基于过去的统计分析得出的，假定未来是过去的延伸，利用历史方法估计波动率类似于估计标的资产收益系列的标准差。

在股票市场中，历史波动率反映标的股价过去的波动。

然而，由于股价波动难以预测，利用历史波动率对权证价格进行预测一般都不能保证准确，但是由于目前我国内地没有权证市场，因而无法获得权证价格，也就无法计算隐含波动率。

因此权证发行商不投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

二、如何计算股票年收益波动率

建议你用股票年收益波动率，具体计算步骤是：1.从finance.yahoo*上面找到你要的公司的股票资料，将其每天的历史价格下载下来，然后选用Adjusted Close Price；2.把它们复制到Excel Spreadsheet里，然后用STDEV计算标准差，就OK了。这是你要的答案么？

三、求助：月度股票波动率计算

月最高点-月最底点/日历天数

四、请问波动率怎么算？

波动率volability其实在经济学里面多指的是方差variance(σ^2) $\bar{x}=31.575$ 平均值,
 $(x-\bar{x})^2/(n-1)=[(34-31.575)^2+(35-31.575)^2+(31.2-31.575)^2+(26.1-31.575)^2]/(4-1)$
 $=19.2709/3=6.42$

五、市场波动率怎么算

提问者采纳

波动率volability其实在经济学里面多指的是方差variance(σ^2) $\bar{x}=31.575$ 平均值,
 $(x-\bar{x})^2/(n-1)=[(34-31.575)^2+(35-31.575)^2+(31.2-31.575)^2+(26.1-31.575)^2]/(4-1)$
 $=19.2709/3=6.42$

六、求谁能帮帮我，如何用EVIEWWS软件，分析股票指数。用最小二乘法和自回归条件异方差用CAPM模型算风险

一般来说用EVIEWWS软件计算出来的是不正确的，尤其是对单个证券的贝塔估计的时候，因为单个证券的收益率一般都不符合正态分布，所以一般要用到连续的复利率，我介绍你用MATHLAB这个软件。

七、用GARCH模型计算波动率的具体步骤是怎样的？特别是参数估计

一般做garch的都是用原始数据，就是上证指数做变换后的数据。

。

波动率有很多种求法，garch就是其中一种。

如果用你的思路和给出的波动率和收益，garch就是arma的方法求波动率。

那就是以波动率平方为因变量，滞后的波动率平方（有的不同阶数可能，用统计量筛选），滞后的收益平方为自变量做回归。

八、请问怎么用EViews实现DCC-GARCH模型？想研究两个金融市场之间的波动溢出效应，求大神~！高分！

EViews只能实现正态分布、t分布、GED分布下的ARCH、GARCH、EGARCH、TGARCH、PARCH等模型的估计，但是像CCC-GARCH、DCC-GARCH等复合GARCH模型的估计EViews是无法实现的。要对这个进行估计的话简单的办法是利用OXmetrix软件做，也可以用R和Matlab编程实现。

参考文档

[下载：eviews如何求股票日波动率.pdf](#)

[《股票交易新股买来多久能买》](#)

[《一般股票持有多久才能赚钱》](#)

[下载：eviews如何求股票日波动率.doc](#)

[更多关于《eviews如何求股票日波动率》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/book/5006546.html>